

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年1月8日提出
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 横山 邦男
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	三島 克哉
【電話番号】	03-5405-0228
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(平成27年7月10日から平成28年7月7日まで) 5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成27年 7月 9日付をもって提出しました「スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040」の有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について、平成28年 1月 8日に半期報告書を提出したことに伴う関係情報の更新、ファンド情報の更新等を行うため、本訂正届出書により訂正を行うものです。

## 2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。また、原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」に中間財務諸表（比較情報を除きます。）の記載事項が追加されます。

## 第一部【証券情報】

## ( 6 ) 【申込単位】

&lt; 訂正前 &gt;

1円以上1円単位

&lt; 訂正後 &gt;

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社または前記「( 4 ) 発行( 売出 ) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

#### (3)【ファンドの仕組み】

<更新後>

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(ハ) 販売会社

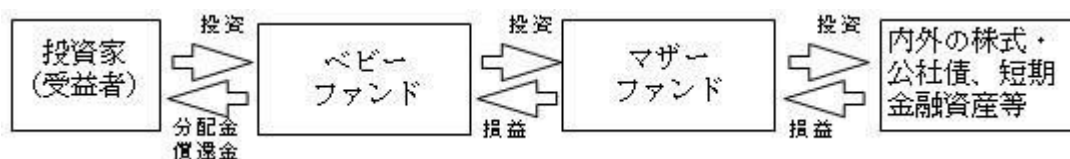
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

#### 運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成27年11月30日現在）

## (ロ) 会社の沿革

昭和60年7月15日	三生投資顧問株式会社設立
昭和62年2月20日	証券投資顧問業の登録
昭和62年6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
平成11年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
平成11年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
平成12年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
平成14年12月1日	住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
平成25年4月1日	トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

## (ハ) 大株主の状況

(平成27年11月30日現在)

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	7,056	40.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	4,851	27.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町二丁目1番1号	882	5.0

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

&lt;更新後&gt;

## イ 基本方針

当ファンドは、マザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、ターゲットイヤーに向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。ターゲットイヤー到達後は、安定した収益の獲得を目指します。

## ロ 投資態度

(イ) 国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産を主要投資対象とする5つのマザーファンドに分散投資を行います。

国内株式	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
国内債券	国内債券パッシブ・マザーファンド
外国株式	外国株式インデックス・マザーファンド
外国債券	外国債券パッシブ・マザーファンド
短期金融資産	マネーインカム・マザーファンド

(ロ) 長期的な視点に基づき時間的経過に従い資産配分を変更し、値上がり益の獲得と配当等収益の獲得により、信託財産の着実な成長を目指した運用を目指します。

(ハ) 基本資産配分は、西暦2040年をターゲットイヤーとし、ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とし、原則として年1回決算時に変更します。

なお、ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネー

インカム・マザーファンドに投資することにより安定した収益の獲得を目指します。

- (二) 組入資産の時価変動により生ずる実際の資産構成比率と基本資産配分との乖離は、資産毎に必要なに応じて調整を行うものとします。
- (ホ) 実質外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行いません。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ファンドの特色

1

日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行います。

■実際の運用は、各資産に投資する5つのマザーファンドへの投資を通じて行います（ファミリーファンド方式）。

■ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドで運用を行います。

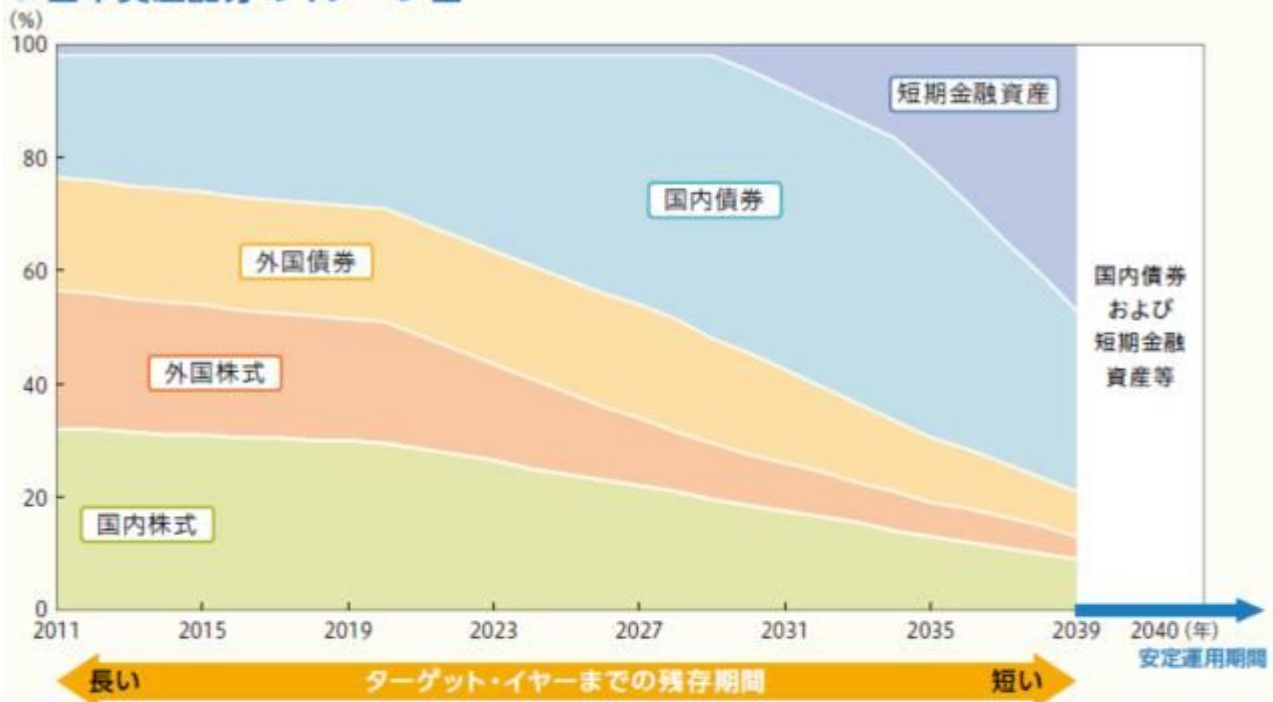
### ▶ ファンドのしくみ



**2** 基本資産配分は、ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とします。

基本資産配分は、原則として年1回決算時に変更します。

### ▶ 基本資産配分のイメージ図



※ 上図は、各決算時点での基本資産配分を表しています。2039年の決算日以降2040年の決算日までには、安定運用期間に向けて、順次、国内株式、外国株式および外国債券への配分を低減していきます。また、現時点で予定している基本資産配分をもとに作成したイメージ図であり、将来、実際に上記の通りの運用を行うことを保証するものではありません。

### [ 2015年5月現在の基本資産配分 ]

国内株式	外国株式	外国債券	国内債券	短期金融資産
31.0%	23.0%	20.0%	24.0%	2.0%

**3** 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

※ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。



## 各マザーファンドの運用プロセス

### ▶国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

- 主としてわが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数、配当込み)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、東証1部銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、マルチファクターモデルを活用した最適化法により、推定トラッキングエラーの低減のみならず制約条件を加えることで、実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。
- TOPIX(東証株価指数、配当込み)との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

### ▶国内債券パッシブ・マザーファンド

- わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA-BPI(総合)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを併用して、層化抽出法により、ファンド規模に応じデュレーション、満期構成、セクター(債券種別)配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りNOMURA-BPI(総合)に近づけたポートフォリオを構築します。なお事業債の銘柄選択については、委託会社クレジットアナリストの調査結果に基づき、将来的に格下げによりNOMURA-BPI(総合)から外れる可能性が高い銘柄については、組入対象から除外することがあります。
- NOMURA-BPI(総合)との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

### ▶外国株式インデックス・マザーファンド

- 主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、マルチファクターモデルを活用した最適化法により推定トラッキングエラーの低減のみならず、制約条件を加えることで実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。
- MSCIコクサイインデックス(円ベース)との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

### ▶外国債券パッシブ・マザーファンド

- 主として日本を除く世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目指した運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを併用して、層化抽出法により、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りシティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に近づけたポートフォリオを構築します。
- シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

### ▶マネーインカム・マザーファンド

- 主として円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。

- ・ TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイインデックス、シティ世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCI Inc.、Citigroup Index LLCが公表している指数で各社の知的財産です。
- ・ 指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

## (4)【分配方針】



## &lt;更新後&gt;

毎年1回（原則として4月13日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と有価証券売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については、前記「（1）投資方針」に基づいて運用を行います。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、収益分配を極力抑制します。（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

## 3【投資リスク】

## &lt;更新後&gt;

## イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、主に内外の株式、債券および短期金融資産を投資対象としています（マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。）。当ファンドの基準価額は、組み入れた株式や債券等の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

当ファンドが有するリスク等（当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドへの投資を通じて間接的に受ける実質的なリスク等を含みます。）のうち主要なものは、以下の通りです。

## (イ) 株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

## (ロ) 債券市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により債券相場が下落（金利が上昇）した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、ファンドが保有する個々の債券については、下記「信用リスク」を負うことにもなります。

## (ハ) 為替変動リスク

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落（円高）する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動（円高）は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

## (ニ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い

場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

(ホ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

(ヘ) 市場流動性リスク

ファンドの資金流出入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ト) 収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(リ) 換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

ロ 投資リスクの管理体制

リスク管理の実効性を高め、また、コンプライアンスの徹底を図るために、運用部門から独立した組織（リスク管理部および法務コンプライアンス部）を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる確認等を行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングを行います。また、法務コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についての確認等を行います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

(参考情報) 投資リスクの定量的比較

## （参考情報）投資リスクの定量的比較



※左グラフは2010年12月～2015年11月の各月末におけるファンドの直近1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。右グラフは同期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

※ファンドの分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額とは異なります。分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金再投資基準価額をもとに計算しており、実際の基準価額をもとに計算したのとは異なります。

※右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものであり、すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### <各資産クラスの指数>

日本株…TOPIX(配当込み)

先進国株…MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース)

日本国債…NOMURA-BPI(国債)

先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債…JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

「TOPIX(配当込み)」は、株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。

「MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース)」は、MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。

「MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース)」は、MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。

「NOMURA-BPI(国債)」は、野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。

「シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」は、Citigroup Index LLCが開発した指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。

「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)」は、J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 4【手数料等及び税金】

## (5) 【課税上の取扱い】

## &lt; 更新後 &gt;

## イ 個別元本について

- (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

## ロ 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

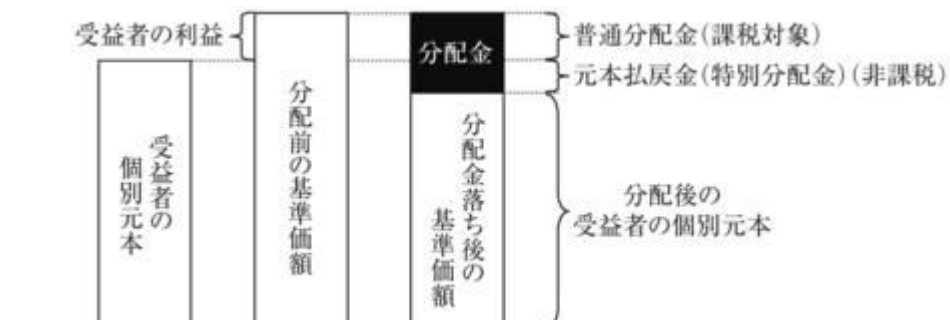
## ハ 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。



収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。





上記、の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・ 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

#### ・ 一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。

### (ロ) 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISAの適用対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドは、受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。また、0歳から19歳の方を対象とした「ジュニアNISA」において、平成28年4月1日より年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となる予定です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

上記にかかわらず、確定拠出年金制度における受益者が支払いを受ける収益分配金、一部解約金、償還金はいずれも課税されません。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成27年11月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

## 5 【運用状況】

< 更新後 >



## ( 1 ) 【投資状況】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040

平成27年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	173,771,412	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,677,628	0.96
合計(純資産総額)		175,449,040	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。以下同じ。

## ( 2 ) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040

## イ 主要投資銘柄

平成27年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	23,299,297	2.3056	53,719,114	2.3013	53,618,672	30.56
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	34,546,009	1.2009	41,488,902	1.2107	41,824,853	23.84
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	13,873,639	2.9394	40,780,414	2.9051	40,304,308	22.97
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	19,311,122	1.8071	34,897,726	1.8045	34,846,919	19.86
日本	親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	3,138,062	1.0121	3,176,108	1.0123	3,176,660	1.81

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.04
合計	99.04

## 【投資不動産物件】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (平成21年 4月13日)	789,754	789,754	7,898	7,898
第2期 (平成22年 4月13日)	921,372	921,372	9,072	9,072
第3期 (平成23年 4月13日)	3,130,163	3,130,163	8,674	8,674
第4期 (平成24年 4月13日)	20,230,023	20,230,023	8,618	8,618
第5期 (平成25年 4月15日)	10,961,140	10,961,140	11,020	11,020
第6期 (平成26年 4月14日)	17,867,281	17,867,281	11,765	11,765
第7期 (平成27年 4月13日)	81,578,616	81,578,616	14,379	14,379
平成26年11月末日	57,843,916		13,768	
12月末日	64,987,005		13,858	
平成27年 1月末日	67,850,874		13,672	
2月末日	71,591,361		14,165	
3月末日	77,867,144		14,234	
4月末日	85,535,827		14,411	
5月末日	123,530,201		14,818	
6月末日	141,552,165		14,516	
7月末日	155,094,727		14,730	
8月末日	154,417,895		14,090	
9月末日	153,567,670		13,538	
10月末日	165,932,212		14,310	
11月末日	175,449,040		14,403	

## 【分配の推移】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
--	------	--------------

第1期	平成20年 3月31日～平成21年 4月13日	0
第2期	平成21年 4月14日～平成22年 4月13日	0
第3期	平成22年 4月14日～平成23年 4月13日	0
第4期	平成23年 4月14日～平成24年 4月13日	0
第5期	平成24年 4月14日～平成25年 4月15日	0
第6期	平成25年 4月16日～平成26年 4月14日	0
第7期	平成26年 4月15日～平成27年 4月13日	0

## 【収益率の推移】

## スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040

	収益率(%)
第1期	21.0
第2期	14.9
第3期	4.4
第4期	0.6
第5期	27.9
第6期	6.8
第7期	22.2
第8期(中間期)	2.2

(注) 収益率とは、計算期間末の分配基準価額から前期末分配基準価額を控除した額を前期末分配基準価額で除したものをいいます。

## (4) 【設定及び解約の実績】

## スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	1,000,000	0
第2期	15,583	0
第3期	2,593,247	0
第4期	19,866,478	0
第5期	5,765,406	19,294,423
第6期	9,427,064	4,186,617
第7期	44,831,283	3,281,608
第8期(中間期)	59,453,937	2,456,157

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

## (参考)

## (1) 投資状況

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

平成27年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	220,246,022,400	98.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,473,209,196	1.99
合計(純資産総額)		224,719,231,596	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,287,220,000	1.90
合計	買建	-	4,287,220,000	1.90

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	203,010,268,640	75.33
地方債証券	日本	19,863,919,707	7.37
特殊債券	日本	28,010,535,001	10.39
社債券	日本	14,871,682,000	5.52
	オランダ	906,662,000	0.34
	オーストラリア	703,207,000	0.26
	アメリカ	604,478,000	0.22
	小計	17,086,029,000	6.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,520,413,804	0.57
合計(純資産総額)		269,491,166,152	100.00

## 外国株式インデックス・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	100,179,777,247	57.56
	イギリス	13,218,900,314	7.60
	スイス	6,770,301,626	3.89
	ドイツ	6,341,952,776	3.64
	フランス	6,289,550,860	3.61
	カナダ	5,741,391,368	3.30
	オーストラリア	3,852,589,300	2.21
	アイルランド	2,899,612,626	1.67
	オランダ	2,795,201,436	1.61
	スペイン	2,310,026,902	1.33
	スウェーデン	1,969,435,986	1.13
	イタリア	1,530,062,240	0.88
	香港	1,529,889,442	0.88
	デンマーク	1,218,914,811	0.70
	ベルギー	993,864,406	0.57
	シンガポール	969,147,657	0.56
	ジャージー	868,138,743	0.50
	フィンランド	619,756,071	0.36
	バミューダ	581,037,664	0.33
	キュラソー	545,175,790	0.31
	イスラエル	446,017,156	0.26
	ケイマン諸島	386,697,648	0.22
	ノルウェー	380,368,475	0.22
	ルクセンブルグ	162,039,410	0.09
	オーストリア	124,287,003	0.07
	ニュージーランド	101,069,074	0.06
	ポルトガル	100,306,330	0.06
	リベリア	89,489,415	0.05
英ヴァージン諸島	49,491,798	0.03	
マン島	16,820,439	0.01	
モーリシャス	10,903,362	0.01	
小計		163,092,217,375	93.71
投資証券	アメリカ	2,816,028,199	1.62
	オーストラリア	561,846,274	0.32



	フランス	252,651,922	0.15
	イギリス	242,833,146	0.14
	香港	95,616,234	0.05
	シンガポール	73,689,079	0.04
	カナダ	29,284,904	0.02
	小計	4,071,949,758	2.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,875,019,476	3.95
合計(純資産総額)		174,039,186,609	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,594,599,172	2.63
	買建	ドイツ	1,277,520,460	0.73
	買建	イギリス	553,541,560	0.31
	買建	オーストラリア	298,246,546	0.17
合計	買建	-	6,723,907,738	3.84

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	85,178,810,729	42.70
	イタリア	19,006,526,412	9.53
	フランス	18,638,284,796	9.34
	イギリス	16,695,190,790	8.37
	ドイツ	14,370,707,209	7.20
	スペイン	10,727,115,197	5.38
	ベルギー	4,929,499,159	2.47
	オランダ	4,882,875,617	2.45
	カナダ	4,012,950,946	2.01
	オーストラリア	3,397,027,938	1.70
	オーストリア	2,945,970,107	1.48
	メキシコ	2,064,853,275	1.04
	アイルランド	1,607,730,190	0.81
	デンマーク	1,321,092,458	0.66
フィンランド	1,117,138,791	0.56	

	ポーランド	1,036,952,337	0.52
	南アフリカ	929,631,435	0.47
	スウェーデン	902,667,331	0.45
	マレーシア	892,570,430	0.45
	シンガポール	681,905,026	0.34
	スイス	595,007,468	0.30
	ノルウェー	571,589,045	0.29
	小計	196,506,096,686	98.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,974,608,581	1.49
合計(純資産総額)		199,480,705,267	100.00

## マネーインカム・マザーファンド

平成27年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	1,280,249,000	96.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		41,734,251	3.16
合計(純資産総額)		1,321,983,251	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成27年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,205,000	7,423.34	8,945,124,700	7,657.00	9,226,685,000	4.11
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,492,300	693.60	5,196,659,280	790.00	5,918,917,000	2.63
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	747,700	4,511.40	3,373,173,780	4,697.00	3,511,946,900	1.56
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	529,100	7,839.37	4,147,810,667	6,537.00	3,458,726,700	1.54
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	851,400	3,602.17	3,066,887,538	4,002.00	3,407,302,800	1.52
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	721,800	3,187.79	2,300,946,822	4,565.00	3,295,017,000	1.47
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,152,900	206.09	2,710,681,161	248.50	3,268,495,650	1.45
日本	株式	KDDI	情報・通信業	948,800	2,535.43	2,405,615,984	3,058.00	2,901,430,400	1.29
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	626,700	3,883.32	2,433,676,644	4,410.00	2,763,747,000	1.23
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	394,700	5,098.91	2,012,539,777	5,983.00	2,361,490,100	1.05

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	390,600	4,481.94	1,750,645,764	5,520.00	2,156,112,000	0.96
日本	株式	ファナック	電気機器	96,800	20,246.58	1,959,868,944	21,920.00	2,121,856,000	0.94
日本	株式	ソニー	電気機器	667,500	2,719.60	1,815,333,000	3,177.00	2,120,647,500	0.94
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	172,800	9,031.10	1,560,574,080	11,620.00	2,007,936,000	0.89
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,109,500	1,714.95	1,902,737,025	1,733.50	1,923,318,250	0.86
日本	株式	村田製作所	電気機器	99,200	13,147.77	1,304,258,784	19,100.00	1,894,720,000	0.84
日本	株式	キヤノン	電気機器	509,200	3,898.53	1,985,131,476	3,716.00	1,892,187,200	0.84
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	84,700	17,605.89	1,491,218,883	21,985.00	1,862,129,500	0.83
日本	株式	三菱地所	不動産業	694,000	2,677.21	1,857,983,740	2,589.50	1,797,113,000	0.80
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,413,000	896.62	2,163,544,060	726.60	1,753,285,800	0.78
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,328,100	1,103.75	1,465,890,375	1,314.50	1,745,787,450	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	378,500	4,005.18	1,515,960,630	4,540.00	1,718,390,000	0.76
日本	株式	花王	化学	266,500	4,485.33	1,195,340,445	6,311.00	1,681,881,500	0.75
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	720,200	1,898.10	1,367,011,620	2,328.00	1,676,625,600	0.75
日本	株式	三井不動産	不動産業	495,000	3,422.78	1,694,276,100	3,104.00	1,536,480,000	0.68
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	298,700	4,370.07	1,305,339,909	5,088.00	1,519,785,600	0.68
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,080,500	1,540.22	1,664,207,710	1,397.50	1,509,998,750	0.67
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	334,300	4,149.05	1,387,027,415	4,380.00	1,464,234,000	0.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	700,600	2,219.58	1,555,037,748	2,072.00	1,451,643,200	0.65
日本	株式	キーエンス	電気機器	21,400	55,493.47	1,187,560,258	66,720.00	1,427,808,000	0.64

□ 種類別・業種別の投資比率

平成27年11月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.35
		建設業	2.82
		食料品	4.33
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.24
		化学	5.96
		医薬品	5.11
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.90
		ガラス・土石製品	0.94
		鉄鋼	1.22
		非鉄金属	0.89
		金属製品	0.67
		機械	4.63
		電気機器	11.91
輸送用機器	10.67		
精密機器	1.53		

	その他製品	1.52
	電気・ガス業	2.02
	陸運業	4.22
	海運業	0.25
	空運業	0.61
	倉庫・運輸関連業	0.20
	情報・通信業	7.12
	卸売業	3.97
	小売業	4.77
	銀行業	8.87
	証券、商品先物取引業	1.19
	保険業	2.47
	その他金融業	1.32
	不動産業	2.72
	サービス業	3.29
合計		98.01

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成27年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	4,195,000,000	105.67	4,433,046,000	105.24	4,414,818,000	1.400	2019/9/20	1.64
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	4,170,000,000	105.53	4,400,601,000	105.15	4,385,046,900	1.300	2019/12/20	1.63
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	4,077,000,000	103.93	4,237,226,100	103.22	4,208,524,020	1.400	2018/3/20	1.56
日本	国債証券	第293回利付国債(10年)	3,660,000,000	105.46	3,860,201,000	104.59	3,828,323,400	1.800	2018/6/20	1.42
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	3,543,000,000	104.88	3,715,898,400	104.21	3,692,302,020	1.500	2018/9/20	1.37
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	3,485,000,000	105.86	3,689,221,000	105.28	3,669,147,400	1.500	2019/6/20	1.36
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	3,380,000,000	104.64	3,536,892,300	104.62	3,536,291,200	1.000	2020/9/20	1.31
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	3,260,000,000	103.96	3,389,167,000	105.00	3,423,228,200	0.800	2023/6/20	1.27
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	3,380,000,000	100.00	3,380,000,000	100.32	3,390,849,800	0.100	2020/3/20	1.26
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	3,070,000,000	104.52	3,208,917,500	103.96	3,191,694,800	1.300	2018/12/20	1.18
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	2,970,000,000	102.13	3,033,261,000	103.39	3,070,683,000	0.600	2024/3/20	1.14
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	2,845,000,000	106.34	3,025,594,500	106.36	3,025,998,900	1.200	2021/6/20	1.12
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	2,770,000,000	105.64	2,926,404,300	105.86	2,932,377,400	1.000	2022/3/20	1.09
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	2,745,000,000	104.77	2,875,936,500	104.26	2,862,129,150	1.300	2019/3/20	1.06

日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	2,700,000,000	100.25	2,706,805,400	100.31	2,708,397,000	0.100	2020/9/20	1.01
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	2,650,000,000	100.05	2,651,573,500	100.31	2,658,400,500	0.100	2020/6/20	0.99
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	2,385,000,000	106.72	2,545,272,000	106.63	2,543,125,500	1.300	2021/3/20	0.94
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	2,465,000,000	99.99	2,464,753,500	101.27	2,496,305,500	0.400	2025/3/20	0.93
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	2,465,000,000	100.84	2,485,708,050	100.95	2,488,466,800	0.400	2025/9/20	0.92
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	2,370,000,000	101.03	2,394,411,000	102.41	2,427,282,900	0.500	2024/9/20	0.90
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	2,385,000,000	100.12	2,387,988,500	101.11	2,411,592,750	0.400	2025/6/20	0.89
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	2,270,000,000	103.93	2,359,211,000	105.05	2,384,657,700	0.800	2023/9/20	0.88
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	105.91	2,271,769,500	105.84	2,270,375,250	1.200	2020/12/20	0.84
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	2,090,000,000	104.09	2,175,602,000	104.86	2,191,762,100	0.800	2022/9/20	0.81
日本	国債証券	第297回利付国債(10年)	1,943,000,000	104.88	2,037,818,400	104.26	2,025,946,670	1.400	2018/12/20	0.75
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	1,905,000,000	102.24	1,947,730,000	103.45	1,970,817,750	0.600	2023/12/20	0.73
日本	国債証券	第337回利付国債(10年)	1,940,000,000	99.03	1,921,182,000	100.53	1,950,301,400	0.300	2024/12/20	0.72
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	1,870,000,000	102.44	1,915,628,000	103.54	1,936,310,200	0.600	2023/3/20	0.72
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	1,830,000,000	102.05	1,867,515,000	103.31	1,890,719,400	0.600	2024/6/20	0.70
日本	国債証券	第324回利付国債(10年)	1,800,000,000	104.14	1,874,520,000	104.75	1,885,644,000	0.800	2022/6/20	0.70

## □ 種類別の投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	75.33
地方債証券	7.37
特殊債券	10.39
社債券	6.34
合計	99.44

## 外国株式インデックス・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成27年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	261,434	14,593.47	3,815,229,863	14,469.42	3,782,799,446	2.17



アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	348,596	5,854.82	2,040,970,110	6,623.68	2,308,989,260	1.33
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	189,629	11,083.27	2,101,710,696	9,976.66	1,891,865,690	1.09
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	456,925	3,241.21	1,480,994,357	3,728.81	1,703,788,885	0.98
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	125,832	13,244.90	1,666,633,364	12,573.08	1,582,096,230	0.91
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	221,959	6,682.63	1,483,271,249	6,802.99	1,509,987,033	0.87
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	17,965	42,058.48	755,580,608	82,689.79	1,485,522,135	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	168,402	7,383.93	1,243,469,995	8,249.81	1,389,286,087	0.80
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	145,954	8,635.05	1,260,321,285	9,104.58	1,328,851,037	0.76
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	13,970	66,491.06	928,880,156	92,146.93	1,287,292,657	0.74
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	96,832	9,653.65	934,782,430	12,951.36	1,254,106,963	0.72
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	13,045	67,681.18	882,901,113	94,813.35	1,236,840,221	0.71
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	279,046	4,258.16	1,188,225,139	4,123.06	1,150,525,466	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	123,110	11,036.60	1,358,716,466	9,297.47	1,144,612,024	0.66
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	279,132	3,829.52	1,068,943,699	4,027.26	1,124,139,316	0.65
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	102,979	11,132.86	1,146,450,934	10,576.33	1,089,140,659	0.63
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	31,777	34,354.32	1,091,677,468	32,831.33	1,043,281,332	0.60
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	73,162	11,386.64	833,069,517	14,140.26	1,034,530,185	0.59
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	185,054	6,202.40	1,147,780,780	5,555.14	1,028,002,469	0.59
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	475,963	2,085.48	992,613,031	2,146.89	1,021,841,919	0.59
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	187,906	5,466.71	1,027,229,150	5,299.68	995,842,234	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	58,895	12,234.10	720,527,332	16,548.76	974,639,621	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	85,222	13,276.84	1,131,479,029	11,099.24	945,899,721	0.54
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	137,529	6,607.71	908,752,574	6,658.07	915,678,012	0.53
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	214,517	4,536.97	973,257,365	4,232.37	907,916,860	0.52
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	66,517	12,329.89	820,147,945	13,264.56	882,318,738	0.51
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	52,852	18,189.64	961,358,959	16,535.25	873,921,382	0.50
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	884,173	1,164.82	1,029,907,699	987.42	873,054,877	0.50
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	88,484	7,936.62	702,264,628	9,805.94	867,669,574	0.50

アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	127,868	7,404.81	946,839,242	6,627.36	847,428,189	0.49
------	----	------------------	------------------------	---------	----------	-------------	----------	-------------	------

□ 種類別・業種別の投資比率

平成27年11月30日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.86
		素材	4.16
		資本財	6.78
		商業・専門サービス	0.89
		運輸	1.77
		自動車・自動車部品	1.69
		耐久消費財・アパレル	1.76
		消費者サービス	1.73
		メディア	2.90
		小売	3.91
		食品・生活必需品小売り	2.02
		食品・飲料・タバコ	6.41
		家庭用品・パーソナル用品	1.70
		ヘルスケア機器・サービス	3.51
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.64
		銀行	8.63
		各種金融	4.17
		保険	4.28
		不動産	0.71
		ソフトウェア・サービス	8.23
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.20		
電気通信サービス	3.11		
公益事業	2.97		
半導体・半導体製造装置	1.69		
投資証券			2.34
合計			96.05

外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成27年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
------	----	-----	----	-------------	-------------	------------------	------------	-----------	------	-----------------

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	11,000,000	12,387.62	1,362,638,772	11,715.87	1,288,746,422	2.750	2042/11/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	8,000,000	12,287.77	983,021,825	12,060.34	964,827,867	2.000	2025/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	7,000,000	12,759.76	893,183,886	12,612.07	882,845,512	2.500	2024/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	7,000,000	12,613.99	882,979,847	12,469.10	872,837,606	2.375	2024/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	7,000,000	12,566.02	879,621,830	12,333.81	863,367,028	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	7,000,000	12,153.61	850,753,139	12,172.61	852,082,941	2.125	2025/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,000,000	12,110.88	847,762,232	12,031.56	842,209,368	2.000	2025/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	14,582.95	874,977,357	13,857.55	831,453,019	3.625	2043/8/15	0.42
イタリア	国債証券	BTPS 6	4,100,000	18,476.72	757,545,881	19,949.30	817,921,638	6.000	2031/5/1	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	13,538.02	812,281,588	13,328.84	799,730,919	3.625	2020/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	13,037.34	808,315,266	12,892.26	799,320,236	2.750	2023/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.875	6,000,000	13,406.57	804,394,238	13,120.63	787,237,819	3.875	2018/5/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000	15,210.89	760,544,810	15,057.63	752,881,890	3.500	2020/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	12,597.68	755,861,151	12,506.53	750,391,819	1.875	2017/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	12,595.76	755,746,007	12,504.61	750,276,675	1.875	2017/9/30	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	15,208.68	760,434,412	14,982.69	749,134,852	3.750	2019/10/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.25	4,800,000	15,457.40	741,955,605	15,404.80	739,430,738	3.250	2021/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.875	6,000,000	12,315.58	738,935,019	12,295.43	737,726,006	0.875	2017/4/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.75	6,000,000	12,309.82	738,589,588	12,282.00	736,920,000	0.750	2017/1/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1	6,000,000	11,967.27	718,036,425	12,049.79	722,987,606	1.000	2019/11/30	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	12,891.18	709,015,296	12,823.17	705,274,659	2.625	2020/11/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000	20,183.35	706,417,320	20,074.90	702,621,577	5.500	2029/4/25	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	3,200,000	21,689.96	694,078,720	21,659.69	693,110,335	5.750	2032/10/25	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	14,133.54	706,677,080	13,734.16	686,708,030	3.750	2017/4/25	0.34
イタリア	国債証券	BTPS 5.25	3,700,000	16,972.71	627,990,580	18,409.19	681,140,074	5.250	2029/11/1	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000	16,958.43	678,337,264	16,889.98	675,599,394	4.250	2023/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,500,000	12,324.98	677,874,285	12,280.08	675,404,451	2.000	2023/2/15	0.34
イタリア	国債証券	BTPS 4.25	4,500,000	14,845.67	668,055,314	14,942.04	672,392,007	4.250	2019/9/1	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	13,610.91	680,545,620	13,430.55	671,527,948	3.625	2021/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	13,473.35	673,667,700	13,265.51	663,275,980	3.625	2019/8/15	0.33

## □ 種類別の投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.51
合計	98.51

## マネーインカム・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄

平成27年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第335回利付国債(2年)	430,000,000	100.02	430,086,000	100.00	430,017,200	0.100	2015/12/15	32.53
日本	国債証券	第338回利付国債(2年)	215,000,000	100.09	215,195,650	100.03	215,073,100	0.100	2016/3/15	16.27
日本	国債証券	第283回利付国債(10年)	200,000,000	101.89	203,780,000	101.46	202,922,000	1.800	2016/9/20	15.35
日本	国債証券	第276回利付国債(10年)	200,000,000	101.09	202,182,000	100.07	200,158,000	1.600	2015/12/20	15.14
日本	国債証券	第280回利付国債(10年)	190,000,000	102.10	193,991,900	101.05	192,008,300	1.900	2016/6/20	14.52
日本	国債証券	第98回利付国債(5年)	40,000,000	100.35	40,140,000	100.17	40,070,400	0.300	2016/6/20	3.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

平成27年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	96.84
合計	96.84

## 投資不動産物件

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

平成27年11月30日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	271	日本円	4,319,690,000	4,287,220,000	1.90

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

平成27年11月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ商業 取引所	SPMINI 1512	買建	358	米ドル	36,941,307.5	4,537,131,387	37,409,210	4,594,599,172	2.63
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 1512	買建	282	ユーロ	9,679,734	1,257,203,851	9,836,160	1,277,520,460	0.73
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI200 1512	買建	26	オースト ラリアド ル	3,341,917	294,489,726	3,384,550	298,246,546	0.17
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FTSE 1512	買建	47	英ポンド	2,943,679	543,403,143	2,998,600	553,541,560	0.31

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 参考情報



基準日: 2015年11月30日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。  
※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 基準価額・純資産の推移



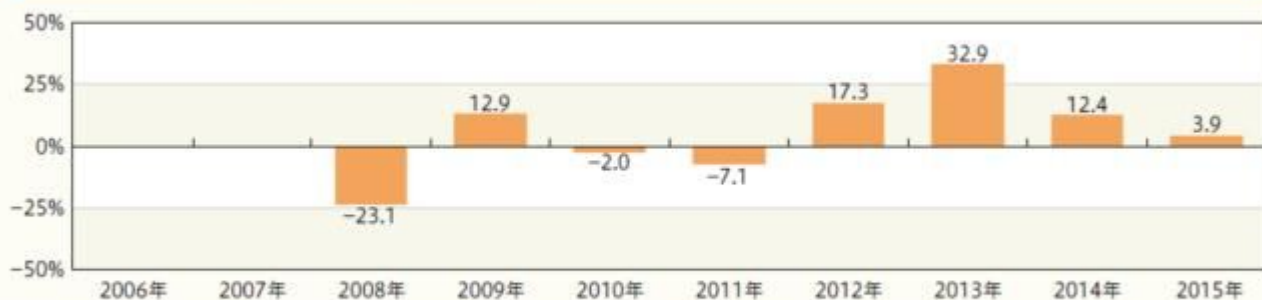
※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 分配の推移

決算期	分配金
2015年4月	0円
2014年4月	0円
2013年4月	0円
2012年4月	0円
2011年4月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2008年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2008年3月31日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2015年のファンドの収益率は、年初から2015年11月30日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

<更新後>

#### イ 申込方法

- (イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。
- (ロ) 原則として午後3時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。
- なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。
- (ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。
- 販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる

口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

ハ 申込手数料

無手数料です。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="http://www.smam-jp.com">http://www.smam-jp.com</a>

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

## 第3【ファンドの経理状況】

&lt;追加&gt;

- 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期中間計算期間(平成27年4月14日から平成27年10月13日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

第8期中間計算期間 (平成27年10月13日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,903,803
親投資信託受益証券	158,381,038
流動資産合計	160,284,841
資産合計	160,284,841
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払受託者報酬	21,606
未払委託者報酬	280,832
その他未払費用	3,543
流動負債合計	305,981
負債合計	305,981
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	113,734,193
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	46,244,667
元本等合計	159,978,860
純資産合計	159,978,860
負債純資産合計	160,284,841

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

第8期中間計算期間 自 平成27年4月14日 至 平成27年10月13日	
<b>営業収益</b>	
受取利息	3
有価証券売買等損益	4,253,373
営業収益合計	4,253,370
<b>営業費用</b>	

第8期中間計算期間 自 平成27年 4月14日 至 平成27年10月13日	
受託者報酬	21,606
委託者報酬	280,832
その他費用	3,543
営業費用合計	305,981
営業利益又は営業損失（ ）	4,559,351
経常利益又は経常損失（ ）	4,559,351
中間純利益又は中間純損失（ ）	4,559,351
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	67,086
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	24,842,203
剰余金増加額又は欠損金減少額	26,999,163
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	26,999,163
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,104,434
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,104,434
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	46,244,667

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第8期中間計算期間 自 平成27年 4月14日 至 平成27年10月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

( 中間貸借対照表に関する注記 )

項目	第8期中間計算期間 (平成27年10月13日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		113,734,193口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4066円
	(10,000口当たりの純資産額)	14,066円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期中間計算期間 (平成27年10月13日現在)	
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第8期中間計算期間 (平成27年10月13日現在)	
期首元本額		56,736,413円
期中追加設定元本額		59,453,937円
期中一部解約元本額		2,456,157円

## （参考）

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

## 貸借対照表

		（単位：円）
		（平成27年10月13日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		2,354,402,376
株式		227,192,584,385
派生商品評価勘定		141,668,080
未収入金		1,984,520
未収配当金		1,719,212,698
未収利息		645
流動資産合計		231,409,852,704
資産合計		231,409,852,704
負債の部		
流動負債		
前受金		141,910,000
未払金		28,061,000
未払解約金		647,869,916
流動負債合計		817,840,916
負債合計		817,840,916
純資産の部		
元本等		
元本		105,364,050,848
剰余金		125,227,960,940
剰余金又は欠損金（ ）		125,227,960,940
元本等合計		230,592,011,788
純資産合計		230,592,011,788
負債純資産合計		231,409,852,704

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成27年 4月14日 至 平成27年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成27年10月13日現在)
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,658,000,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,364,050,848口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.1885円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 21,885円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成27年10月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

項目	(平成27年10月13日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成27年10月13日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,224,810,000	-	3,366,720,000	141,910,000
	東証株価指数先物	3,224,810,000	-	3,366,720,000	141,910,000
合計		3,224,810,000	-	3,366,720,000	141,910,000

(注)1.時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成27年10月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	119,948,691,565円
同期中における追加設定元本額	9,095,499,823円
同期中における一部解約元本額	23,680,140,540円
平成27年10月13日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,473,229,434円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	456,435,992円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,363,797,486円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,728,204,663円
SMA・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	84,384,455円



（平成27年10月13日現在）	
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	7,312,741円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	15,981,708円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	54,889,113円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	39,254,344円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	22,840,492円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	51,166,475円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	2,202,115,532円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	788,363,075円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	141,086,041円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	303,447,131円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	411,466,404円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	17,238,682,701円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	161,393,931円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	20,117,156,478円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	8,180,761,505円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	3,926,831,246円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	14,383,473,552円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	83,767,644円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	332,416,041円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	25,377,191円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,555,427,927円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	80,292,896円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	542,788,810円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,672,830,912円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	2,801,462,826円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	5,139,963,947円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	122,119,741円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	3,813,669,074円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	99,843,434円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	176,855,278円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	3,121,385,812円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	150,789,736円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	75,843,641円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	33,404,750円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	347,417,358円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	617,758,500円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	237,944,409円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	170,018,923円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	91,177,546円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	12,916,740円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	127,112,524円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	1,474,743,609円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA（適格機関投資家専用）	272,917,249円

（平成27年10月13日現在）	
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T2 < 適格機関投資家専用 >	28,602,130円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	305,920円
S M A M ・ F G グローバルバランス25VA < 適格機関投資家限定 >	2,621,781円
合計	105,364,050,848円

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

（平成27年10月13日現在）

## 資産の部

## 流動資産

コール・ローン	715,477,584
国債証券	202,783,008,800
地方債証券	21,196,365,169
特殊債証券	29,186,287,138
社債証券	17,833,357,000
未収入金	616,247,200
未収利息	655,138,824
前払費用	10,786,745

流動資産合計 272,996,668,460

## 資産合計

272,996,668,460

## 負債の部

## 流動負債

未払金	605,773,000
未払解約金	48,977,164

流動負債合計 654,750,164

## 負債合計

654,750,164

## 純資産の部

## 元本等

元本	225,106,821,414
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	47,235,096,882

元本等合計 272,341,918,296

## 純資産合計

272,341,918,296

## 負債純資産合計

272,996,668,460

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成27年 4月14日 至 平成27年10月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成27年10月13日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		225,106,821,414口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2098円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,098円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成27年10月13日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成27年10月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	249,296,427,435円
同期中における追加設定元本額	3,941,720,542円
同期中における一部解約元本額	28,131,326,563円
平成27年10月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	2,197,109,579円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,119,351,490円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	919,120,914円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	293,682,582円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	46,858,363円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	75,563,847円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	157,205,319円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	62,302,517円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	30,688,645円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	57,526,736円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	2,085,208円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,459,991,102円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	620,840,310円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	482,418,196円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	6,112,629,465円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	38,494,315,408円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	10,712,598,511円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	26,200,111,556円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	455,306,296円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	792,505,367円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	80,111,530円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	398,863,601円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	142,165,424円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	2,624,785,835円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	3,047,089,989円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	7,781,477,757円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	16,445,506,912円
S M A M ・ バランスV A 株4 0 T <適格機関投資家限定>	233,157,890円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	8,243,676,123円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	41,156,946,622円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A <適格機関投資家限定>	734,928,899円

(平成27年10月13日現在)	
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	1,333,881,895円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	26,317,121,156円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	1,221,186,605円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	277,852,978円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	60,891,217円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	3,097,376,061円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	3,703,097,827円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	3,306,018,656円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	1,336,805,496円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	324,159,210円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	23,327,147円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	539,879,667円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	8,962,922,744円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	405,581,008円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	611,848円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	9,291,025円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型) < 適格機関投資家限定 >	1,454,849円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ファンド < 適格機関投資家限定 >	4,440,032円
合計	225,106,821,414円

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(平成27年10月13日現在)

## 資産の部

## 流動資産

預金	921,126,919
コール・ローン	516,379,280
株式	166,300,340,567
投資証券	4,128,087,330
派生商品評価勘定	59,202,979
未収入金	1,275,578
未収配当金	193,508,837
未収利息	141
差入委託証拠金	1,250,718,780
流動資産合計	173,370,640,411

## 資産合計

173,370,640,411

## 負債の部

## 流動負債

前受金	59,202,979
未払解約金	426,535,624
流動負債合計	485,738,603

## 負債合計

485,738,603

## 純資産の部

## 元本等

元本	62,027,446,028
----	----------------

(平成27年10月13日現在)

剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	110,857,455,780
元本等合計	172,884,901,808
純資産合計	172,884,901,808
負債純資産合計	173,370,640,411

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成27年4月14日 至平成27年10月13日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成27年10月13日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		62,027,446,028口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.7872円
	(10,000口当たりの純資産額)	27,872円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成27年10月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(平成27年10月13日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,455,979,445	-	2,515,182,424	59,202,979
	SPMINI 1512	1,657,282,278	-	1,700,512,557	43,230,279
	DJ EUR 1512	482,740,302	-	490,139,236	7,398,934
	FTSE 1512	202,725,637	-	209,667,931	6,942,294
	SPI200 1512	113,231,228	-	114,862,700	1,631,472
合計		2,455,979,445	-	2,515,182,424	59,202,979

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成27年10月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,552,562,996円
同期中における追加設定元本額	5,660,783,836円
同期中における一部解約元本額	13,185,900,804円
平成27年10月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	7,885,385,206円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	178,844,752円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	800,505,479円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	547,146,628円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	38,435,789円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,642,623円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	6,111,246円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	26,153,071円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	22,633,014円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	13,406,495円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	30,655,879円
外国株式指数ファンド	404,635,099円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	158,497,579円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	61,642,387円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	156,077,150円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	207,596,591円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	8,848,237,734円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	62,598,858円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	7,457,283,297円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	4,274,911,778円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	2,758,024,860円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	11,540,051,912円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	32,713,237円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	179,228,687円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	14,603,300円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	1,399,515,761円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定>	96,824,127円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	282,637,008円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	1,356,627,905円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	2,279,780,830円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	3,084,442,628円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	98,842,924円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,244,516,567円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,019,484,997円



（平成27年10月13日現在）	
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	243,653,872円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	140,865,555円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	2,447,942,230円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	38,232,319円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	23,282,332円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,369,463円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	88,350,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	204,710,928円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	193,834,073円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	243,873円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	4,206,135円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	60,059,825円
合計	62,027,446,028円

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

（平成27年10月13日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	580,030,080
コール・ローン	304,105,592
国債証券	200,287,933,080
派生商品評価勘定	505,057
未収入金	787,779,673
未収利息	1,961,039,688
前払費用	38,190,799
流動資産合計	203,959,583,969
資産合計	
203,959,583,969	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,253,801
未払解約金	321,455,531
流動負債合計	323,709,332
負債合計	
323,709,332	
純資産の部	
元本等	
元本	112,101,814,213
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	91,534,060,424
元本等合計	203,635,874,637
純資産合計	
203,635,874,637	
負債純資産合計	
203,959,583,969	

### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成27年 4月14日 至 平成27年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	( 平成27年10月13日現在 )	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		112,101,814,213口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.8165円
	(10,000口当たりの純資産額	18,165円)

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	( 平成27年10月13日現在 )
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

項目	(平成27年10月13日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成27年10月13日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	418,021	-	418,000	21
	ユーロ	418,021	-	418,000	21
	売建	792,742,806	-	794,491,529	1,748,723
	米ドル	379,428,838	-	379,306,773	122,065
	カナダドル	96,073,074	-	95,690,082	382,992
	ユーロ	317,240,894	-	319,494,674	2,253,780
合計		793,160,827	-	794,909,529	1,748,744

(注) 1.時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

1)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

- ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。

- ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

（平成27年10月13日現在）

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	125,043,526,611円
同期中における追加設定元本額	3,210,452,108円
同期中における一部解約元本額	16,152,164,506円
平成27年10月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	6,565,481,789円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	266,496,035円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	800,455,583円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	412,992,435円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	61,839,905円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	7,524,799円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	18,123,727円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	53,143,709円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	30,883,884円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	17,095,811円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	36,667,550円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	371,584円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	47,380,622円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	99,814,551円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	134,685,079円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,469,628,306円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	5,389,851,237円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	22,529,057,030円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	7,763,692,836円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	17,498,444,538円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	51,623,829円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	136,785,799円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	14,659,440円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,054,541,372円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	142,952,399円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,562,623,327円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,982,684,676円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	5,098,844,222円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	9,449,760,802円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	156,544,043円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA＜適格機関投資家限定＞	14,571,451,863円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,359,010,774円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	4,576,505,590円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	250,050,101円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	885,928,082円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	3,951,281,981円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	187,389,261円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	55,642,262円

(平成27年10月13日現在)	
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	17,748,606円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	217,600,238円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	769,527,523円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	228,744,465円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	205,790,663円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	65,026,325円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	6,703,484円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,842,143,833円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	28,019,233円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	2,420,864円
S M A M ・ F G グローバルバランス2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	25,121,875円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロス・ファンド(安定成長型) < 適格機関投資家限定 >	1,056,271円
合計	112,101,814,213円

## マネーインカム・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(平成27年10月13日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	19,063,950
国債証券	1,291,689,650
未収利息	2,481,926
前払費用	95,424
流動資産合計	1,313,330,950
資産合計	1,313,330,950
負債の部	
流動負債	
未払解約金	6,204,237
流動負債合計	6,204,237
負債合計	6,204,237
純資産の部	
元本等	
元本	1,291,334,954
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	15,791,759
元本等合計	1,307,126,713
純資産合計	1,307,126,713
負債純資産合計	1,313,330,950

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成27年 4月14日 至 平成27年10月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成27年10月13日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		1,291,334,954口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0122円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,122円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成27年10月13日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成27年10月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,480,579,600円
同期中における追加設定元本額	241,988,764円
同期中における一部解約元本額	431,233,410円
平成27年10月13日現在における元本の内訳	
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	25,813,064円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	7,837,671円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	8,666,012円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	5,091,507円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	2,812,071円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	5,989,139円
日興ニューバーク米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
日興ニューバーク米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	401,247,333円
S M A M ・ バランス先物ファンドV A 2 0 <適格機関投資家限定>	653,649,487円
S M A M ・ F G マネーファンドV A <適格機関投資家限定>	179,832,158円
合計	1,291,334,954円

## 2【ファンドの現況】

&lt;更新後&gt;

## 【純資産額計算書】

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040

平成27年11月30日現在

資産総額	175,548,852円
負債総額	99,812円
純資産総額( - )	175,449,040円
発行済口数	121,815,817口
1口当たり純資産額( / )	1.4403円
(1万口当たり純資産額)	(14,403円)

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

<更新後>

###### イ 資本金の額および株式数

	平成27年11月30日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減  
該当ありません。

###### ハ 会社の機構

委託会社の取締役は7名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

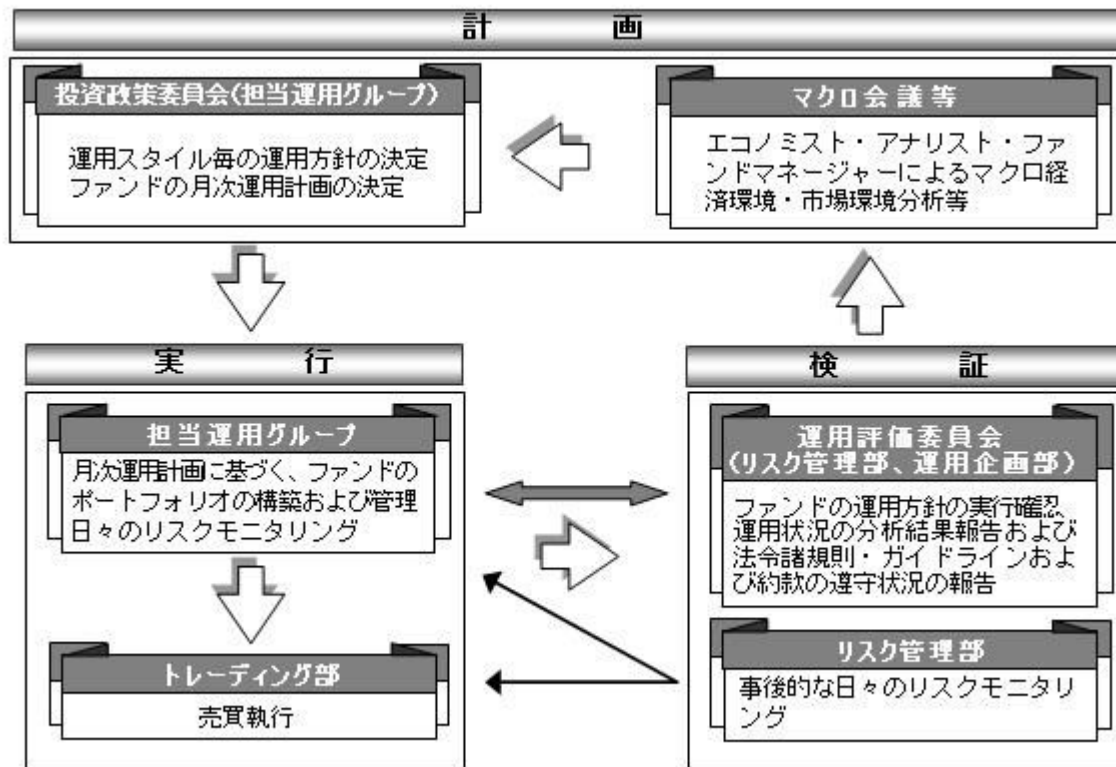
委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名のほか、取締役副社長、専務取締役、常務取締役を若干名選定することができます。

###### ニ 投資信託の運用の流れ





## 2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成27年11月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成27年11月30日現在）

		本 数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	50 ( 13 )	159,994 ( 52,202 )
	追加型	462 ( 186 )	5,192,745 ( 2,862,862 )
	計	512 ( 199 )	5,352,739 ( 2,915,063 )
公社債投資信託	単位型	44 ( 44 )	191,690 ( 191,690 )
	追加型	4 ( 1 )	255,686 ( 176,487 )
	計	48 ( 45 )	447,376 ( 368,177 )
合 計		560 ( 244 )	5,800,115 ( 3,283,241 )

( )内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

## 3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2 当社は、第30期（平成26年4月1日から平成27年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第31期中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

		（単位：千円）	
		前事業年度 （平成26年3月31日）	当事業年度 （平成27年3月31日）
資産の部			
流動資産			
現金及び預金	2	20,615,467	25,021,336
有価証券		4,999,802	-
前払費用		257,741	291,119
未収入金		4,026	41,860
未収委託者報酬		4,128,531	4,897,032
未収運用受託報酬		934,710	1,000,744
未収投資助言報酬	2	453,941	455,390
未収収益		11,700	13,030
繰延税金資産		548,658	475,859
その他の流動資産		4,577	52,473
流動資産合計		31,959,157	32,248,847
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	124,723	120,234
器具備品		204,970	230,712
有形固定資産合計		329,694	350,947
無形固定資産			
ソフトウェア		517,480	497,668
ソフトウェア仮勘定		4,595	77,155
電話加入権		103	91
商標権		468	222
無形固定資産合計		522,646	575,137
投資その他の資産			
投資有価証券		6,843,224	7,151,933
関係会社株式		353,036	509,146
長期差入保証金		541,904	600,480
長期前払費用		41,193	36,031
会員権		9,480	17,299
繰延税金資産		463,476	665,425

投資その他の資産合計	8,252,316	8,980,317
固定資産合計	9,104,657	9,906,402
資産合計	41,063,815	42,155,249

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	61,327	82,723
未払金		
未払収益分配金	671	711
未払償還金	143,230	143,201
未払手数料	2,138,441	2,338,432
その他未払金	203,170	1,075,587
未払費用	1,615,419	2,095,111
未払消費税等	215,390	478,421
未払法人税等	1,623,022	454,520
賞与引当金	926,263	906,623
その他の流動負債	8	808
流動負債合計	6,926,944	7,576,142
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	1,802,340	2,633,080
固定負債合計	1,802,340	2,633,080
負債合計	8,729,285	10,209,222
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	19,227,103	18,861,359
利益剰余金合計	21,048,308	20,682,564
株主資本計	31,677,292	31,311,548
<b>評価・換算差額等</b>		
<b>その他有価証券</b>		
評価差額金	657,238	634,478
評価・換算差額等合計	657,238	634,478
純資産合計	32,334,530	31,946,027
負債・純資産合計	41,063,815	42,155,249

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)		(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	30,300,842		30,094,858	
運用受託報酬	3,773,696		3,862,895	
投資助言報酬	2,117,669		2,106,161	
その他営業収益				
情報提供コンサルタント 業務報酬	5,000		5,000	
投資法人運用受託報酬	26,625		27,345	
サービス支援手数料	24,883		18,274	
その他	56,406		52,255	
営業収益計	36,305,122		36,166,790	
営業費用				
支払手数料	15,695,322		15,123,724	
広告宣伝費	276,591		407,991	
公告費	5,637		4,737	
調査費				
調査費	1,028,700		1,319,743	
委託調査費	3,053,376		3,550,675	
営業雑経費				
通信費	38,776		38,911	
印刷費	262,934		294,002	
協会費	14,337		26,955	
諸会費	32,186		18,577	
情報機器関連費	2,277,699		2,403,857	
販売促進費	40,388		28,281	
その他	117,451		144,250	
営業費用合計	22,843,403		23,361,707	
一般管理費				
給料				
役員報酬	140,440		190,241	
給料・手当	4,900,885		5,186,853	
賞与	786,372		569,685	
賞与引当金繰入額	926,263		906,623	
交際費	24,915		22,609	
寄付金	82		-	
事務委託費	303,945		366,661	
旅費交通費	196,933		226,254	
租税公課	100,575		108,953	
不動産賃借料	546,821		552,589	
退職給付費用	330,002		387,799	
固定資産減価償却費	227,090		287,833	
諸経費	258,736		283,156	
一般管理費合計	8,743,067		9,089,262	
営業利益	4,718,652		3,715,820	
営業外収益				
受取配当金	50,559		26,821	

有価証券利息		2,660	1,187
受取利息	1	5,190	6,113
時効成立分配金・償還金		5,958	12
原稿・講演料		2,456	1,899
還付加算金		182	-
雑収入		3,692	7,324
営業外収益合計		70,701	43,357
営業外費用			
為替差損		29,406	14,361
雑損失		38	-
営業外費用合計		29,444	14,361
経常利益		4,759,909	3,744,816
特別利益			
投資有価証券償還益		8,250	4,181
投資有価証券売却益		310,894	893,251
負ののれん発生益		186,047	-
企業結合に係る 特定勘定取崩益		2,870	-
特別利益合計		508,062	897,432
特別損失			
固定資産除却損	2	6,717	1,076
投資有価証券償還損		2,337	-
投資有価証券評価損		1,280	-
投資有価証券売却損		454	1,091
合併関連費用		17,767	-
事務所移転費用		1,313	-
その他の特別損失	3	-	973,862
特別損失合計		29,870	976,030
税引前当期純利益		5,238,102	3,666,218
法人税、住民税及び事業税		2,147,762	1,574,213
法人税等調整額		282,886	166,505
法人税等合計		1,864,875	1,740,718
当期純利益		3,373,226	1,925,499

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				株主資本 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	16,718,237	18,539,441	29,168,425
当期変動額									
剰余金の配当							864,360	864,360	864,360
当期純利益							3,373,226	3,373,226	3,373,226
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,508,866	2,508,866	2,508,866
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	529,488	529,488	29,697,914
当期変動額			
剰余金の配当			864,360
当期純利益			3,373,226
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	127,749	127,749	127,749
当期変動額合計	127,749	127,749	2,636,616
当期末残高	657,238	657,238	32,334,530

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292
会計方針の変更 による累積的影響額							439,043	439,043	439,043
会計方針の変更を反映 した当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,788,060	20,609,264	31,238,248
当期変動額									
剰余金の配当							1,852,200	1,852,200	1,852,200
当期純利益							1,925,499	1,925,499	1,925,499
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	73,299	73,299	73,299
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	657,238	657,238	32,334,530
会計方針の変更 による累積的影響額			439,043
会計方針の変更を反映 した当期首残高	657,238	657,238	31,895,486
当期変動額			
剰余金の配当			1,852,200
当期純利益			1,925,499
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	22,759	22,759	22,759
当期変動額合計	22,759	22,759	50,540
当期末残高	634,478	634,478	31,946,027

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 満期保有目的の債券

償却原価法

## (2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

## (2) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## (会計方針の変更)

## (退職給付に関する会計基準等の適用)

「退職給付に関する会計基準」(企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会

計基準」という。)及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第25号平成27年3月26日。以下「退職給付適用指針」という。)を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が682,168千円、繰延税金資産が243,124千円増加し、繰越利益剰余金が439,043千円減少しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ28,067千円減少しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

#### (貸借対照表関係)

##### 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
建物	241,339千円	258,412千円
器具備品	704,790千円	783,602千円

##### 2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
現金及び預金	14,959,545千円	18,853,119千円
未収投資助言報酬	290,426千円	286,990千円
未払手数料	360,659千円	392,772千円

3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当事業年度末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	-千円	-千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

##### 4 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、前事業年度は平成27年6月まで、当事業年度は平成35年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	27,470千円	355,376千円

#### (損益計算書関係)

1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	前事業年度 (自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)	当事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
受取利息	2,104千円	2,463千円

##### 2 固定資産除却損



	前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)	当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)
器具備品	864千円	1,076千円
ソフトウェア	5,853千円	- 千円
計	6,717千円	1,076千円

### 3 その他の特別損失

その他の特別損失は、中国において同国国家税務総局が平成26年11月17日付で公布した財税[2014]79号通達に基づき、当社が委託者として運用する証券投資信託に関し、適格国外機関投資家として課される平成21年11月17日から平成26年11月16日までに行われた中国A株投資のキャピタル・ゲインに対して遡及的に徴される源泉所得税等について納付すべきと見込まれる金額を計上したものであります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

#### 1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

#### 2. 剰余金の配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年 6月24日 定時株主総会	普通株式	864,360	49,000	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

##### (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

平成26年 6月26日開催の第29回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の 総額(千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年 6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26年 6月27日

当事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

#### 1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

#### 2. 剰余金の配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年 6月26日 定時株主総会	普通株式	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26年 6月27日

##### (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

平成27年 6月30日開催の第30回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の 総額(千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年 6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	952,560	54,000	平成27年 3月31日	平成27年 7月 1日

## (リース取引関係)

## オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
1年以内	525,188	572,402
1年超	751,482	1,340,637
合計	1,276,671	1,913,040

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っています。そのため、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

有価証券及び投資有価証券については、主に満期保有目的の債券及び事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の海外子会社の株式及び50%出資した海外関連会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について、取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。

満期保有目的の債券は、余資運用規則に基づき、短期の国債のみを対象としているため、信用リスクは僅少であります。

有価証券、投資有価証券、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

長期差入保証金についても、差入先の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

## 市場リスクの管理

有価証券及び投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、

これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません(注2)参照)。

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	20,615,467	20,615,467	-
(2)未収委託者報酬	4,128,531	4,128,531	-
(3)未収運用受託報酬	934,710	934,710	-
(4)未収投資助言報酬	453,941	453,941	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	4,999,802	4,999,500	302
其他有価証券	6,811,166	6,811,166	-
(6)長期差入保証金	541,904	541,904	-
資産計	38,485,524	38,485,221	302
(1)未払金			
未払手数料	2,138,441	2,138,441	-
負債計	2,138,441	2,138,441	-

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	25,021,336	25,021,336	-
(2)未収委託者報酬	4,897,032	4,897,032	-
(3)未収運用受託報酬	1,000,744	1,000,744	-
(4)未収投資助言報酬	455,390	455,390	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	-	-	-
其他有価証券	7,131,075	7,131,075	-
(6)長期差入保証金	600,480	600,480	-
資産計	39,106,059	39,106,059	-
(1)未払金			
未払手数料	2,338,432	2,338,432	-
負債計	2,338,432	2,338,432	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

### 資 産

(1)現金及び預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬、及び(4)未収投資助言報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(5)有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6)長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいこと

から、当該帳簿価額によっています。

## 負債

### (1)未払金

未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
その他有価証券		
非上場株式	298	298
投資証券	31,760	20,560
合計	32,058	20,858
子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	353,036	509,146
合計	353,036	509,146

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成26年3月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,615,467	-	-	-
未収委託者報酬	4,128,531	-	-	-
未収運用受託報酬	934,710	-	-	-
未収投資助言報酬	453,941	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	5,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち				
満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	23,475	518,429	-	-
合計	31,156,125	518,429	-	-

当事業年度（平成27年3月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	25,021,336	-	-	-
未収委託者報酬	4,897,032	-	-	-
未収運用受託報酬	1,000,744	-	-	-
未収投資助言報酬	455,390	-	-	-
長期差入保証金	4,148	596,332	-	-
合計	31,378,651	596,332	-	-

(有価証券関係)

## 1. 満期保有目的の債券

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2) 貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの			
国債	4,999,802	4,999,500	302
小計	4,999,802	4,999,500	302
合計	4,999,802	4,999,500	302

当事業年度(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成26年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式353,036千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成27年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式509,146千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 3. その他有価証券

前事業年度(平成26年3月31日)

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	6,390,685	5,387,490	1,003,195
小計	6,390,685	5,387,490	1,003,195
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	420,480	424,165	3,684
小計	420,480	424,165	3,684
合計	6,811,166	5,811,655	999,510

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 32,058千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,280千円です。

当事業年度(平成27年3月31日)

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	5,826,531	4,894,554	931,977
小計	5,826,531	4,894,554	931,977
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	1,304,543	1,312,300	7,756
小計	1,304,543	1,312,300	7,756
合計	7,131,075	6,206,854	924,220

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 20,858千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,097,321	310,894	454

当事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
3,892,685	893,251	1,091

(退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

## 2. 確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)	当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,605,470	1,802,340
会計方針の変更による 累積的影響額	-	682,168
会計方針の変更を反映した期首残高	1,605,470	2,484,508
勤務費用	184,549	217,881
利息費用	25,192	18,161
数理計算上の差異の発生額	21,670	276
退職給付の支払額	93,535	87,196
過去勤務費用の発生額	27,157	-
その他	75,176	-
退職給付債務の期末残高	1,802,340	2,633,080

(注) その他は、トヨタアセットマネジメント株式会社との合併により引き継いだ退職給付債務額になります。

## (2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成26年 3月31日)	当事業年度 (平成27年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	1,802,340	2,633,080
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	1,802,340	2,633,080

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)	当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)
勤務費用	184,549	217,881
利息費用	25,192	18,161
数理計算上の差異の費用処理額	21,670	276

過去勤務費用の費用処理額	27,157	-
その他	114,773	152,031
確定給付制度に係る退職給付費用	330,002	387,799

（注）その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額になります。

#### (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

	前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月 31日)	当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月 31日)
割引率	1.5%	0.731%

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度43,539千円、当事業年度105,357千円であります。

#### (税効果会計関係)

##### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成26年 3月31日)	当事業年度 (平成27年 3月31日)
(単位：千円)		
流動の部		
繰延税金資産		
未払金	-	321,602
賞与引当金	330,120	299,729
調査費	62,002	77,863
未払事業税	123,029	49,504
その他	33,507	48,762
繰延税金資産小計	548,658	797,462
評価性引当額	-	321,602
繰延税金資産合計	548,658	475,859
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	642,354	849,431
特定外国子会社留保金額	226,680	211,024
ソフトウェア償却	105,651	62,560
投資有価証券評価損	50,143	43,051
その他	6,970	6,291
繰延税金資産小計	1,031,799	1,172,360
評価性引当額	233,276	217,192
繰延税金資産合計	798,523	955,168
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	334,588	289,742
その他	457	-
繰延税金負債合計	335,046	289,742
繰延税金資産の純額	1,012,135	1,141,285

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
法定実効税率	38.0%	35.6%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.5	9.6
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.3	0.2
受取配当等永久に益金に算入されない項目	-	0.5
住民税均等割等	0.1	0.2
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.7	3.7
所得税額控除による税額控除	-	1.3
負ののれん発生益	1.3	-
企業結合に係る特定勘定取崩	1.5	-
その他	0.1	0.1
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.6	47.5

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布されたことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算（ただし、平成27年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の35.6%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成27年4月1日から平成28年3月31日までのものは33.1%、平成28年4月1日以降のものについては32.3%にそれぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が106,175千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が136,532千円、その他有価証券評価差額金が30,357千円それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自平成25年4月1日至平成26年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	30,300,842	3,773,696	2,117,669	112,914	36,305,122

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報



外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

当社は単一セグメントのため、記載を省略しております。

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	30,094,858	3,862,895	2,106,161	102,874	36,166,790

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) % 直接 40	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	3,299,099	未払手数料	257,411
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	270,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接27.5	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,127,963	未収投資助言報酬	290,426

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(2) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 子会社及び関連会社等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	3,000,000 (シンガポールドル)	投資運用業	(所有) % 直接50	投信の販売委託 役員の兼任	出資の引受	118,725	-	-

(注) 1. UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。

## 3. その他の関係会社の子会社等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMB C日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,037,816	未払手数料	403,591

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) % 直接 40	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,527,962	未払手数料	289,954
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	270,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接27.5	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,072,459	未収投資助言報酬	286,990

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(2) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 子会社及び関連会社等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
----	------------	-----	-------------	-----------	----------------	-----------	-------	------	----	------

子会社	ソーラーエナジー投資合同会社	東京都港区	20,000	投資運用業	(所有) % 直接100	投資事業有限責任組合の運営及び管理	出資の引受	20,000	-	-
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	6,000,000 (シンガポールドル)	投資運用業	(所有) % 直接50	投信の販売委託 役員の兼任	増資の引受	136,110	-	-

- (注) 1. ソーラーエナジー投資合同会社の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。  
2. UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.の増資の引受については、当社とUOBアセットマネジメント社がそれぞれ1,500,000(シンガポールドル)出資しました。

### 3. その他の関係会社の子会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMB C日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,705,879	未払手数料	697,658

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。  
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等  
(1)投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

### (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1株当たり純資産額	1,833,023.27円	1,810,999.27円
1株当たり当期純利益金額	191,226.00円	109,155.30円

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。  
2. 「会計方針の変更に関する注記」に記載のとおり、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当事業年度の期首の1株当たり純資産額が、24,889円09銭減少し、1株当たり当期純利益金額は、1,591円10銭減少しております。  
3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	3,373,226	1,925,499
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	3,373,226	1,925,499
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

### (重要な後発事象)

#### 1. 日興グローバルラップ株式会社の株式の取得(子会社化)について

当社は、平成26年12月26日開催の取締役会において、当社が日興グローバルラップ株式会社(以下「NGW」)の発行済株式の全部を取得し子会社化することを決議し、平成26年12月26日付にて株式譲渡契約を締結し、平成27年4月1日付にて発行済株式を取得いたしました。

#### (1)株式取得の目的

NGWは、国内外資産の効率的な配分と、海外運用会社の評価・選定に特化した大変特徴ある運用

会社であり、既に「日興・新経済成長国エクイティ・ファンド(EG5)」や「日興ワールド CB ファンド」等の商品で当社と協働しております。本件子会社化は、外部委託運用機能の強化、アセットアロケーション機能の強化及びファンドラップビジネスへの参画の3つの分野において当社事業に対するプラスをもたらすと考えております。今後、当社はNGWと双方のリソースを活用した相乗効果の醸成を進め、更なるビジネスの拡大を目指していく考えです。

## (2)取得する会社の概要(平成26年3月末現在)

名称	日興グローバルラップ株式会社
事業の内容	投資運用業等
資本金	1,499,000千円
純資産	7,620,283千円
総資産	8,134,920千円
営業利益	501,574千円
当期純利益	303,382千円

## (3)株式取得日

平成27年4月1日

## (4)取得する株式の数、取得価額及び取得後の持株比率

取得株式数	59,960株
取得価額	9,877,717千円
取得後の持株比率	100%

## (5)支払資金の調達方法

自己資金によります。

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位:千円)

		第31期中間会計期間 (平成27年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		10,975,719
顧客分別金信託		20,003
前払費用		325,776
未収委託者報酬		5,173,183
未収運用受託報酬		1,458,560
未収投資助言報酬		423,030
未収収益		31,637
繰延税金資産		519,032
その他		2,190
流動資産合計		18,929,133
固定資産		
有形固定資産	1	421,791
無形固定資産		573,943
投資その他の資産		
投資有価証券		10,008,703
関係会社株式		10,412,523
その他		1,298,972
投資その他の資産合計		21,720,199
固定資産合計		22,715,935

資産合計		41,645,068
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		29
その他の預り金		61,740
未払金		2,614,352
未払費用		1,987,591
未払法人税等		406,231
賞与引当金		1,066,694
その他	2	169,290
流動負債合計		6,305,931
固定負債		
退職給付引当金		2,705,437
固定負債合計		2,705,437
負債合計		9,011,368
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
資本剰余金合計		8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		19,580,326
利益剰余金合計		21,401,531
株主資本合計		32,030,515
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		603,184
評価・換算差額等合計		603,184
純資産合計		32,633,699
負債純資産合計		41,645,068

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

第31期中間会計期間	
(自 平成27年4月1日	
至 平成27年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	16,529,753
運用受託報酬	2,843,500
投資助言報酬	978,992
その他の営業収益	64,711
営業収益計	20,416,958

営業費用		13,207,542
一般管理費	1	5,203,152
営業利益		2,006,263
営業外収益	2	41,105
営業外費用	3	48,535
経常利益		1,998,832
特別利益	4	34,739
特別損失		7,932
税引前中間純利益		2,025,639
法人税、住民税及び事業税		368,130
法人税等調整額		14,018
法人税等合計		354,112
中間純利益		1,671,526

## (3)中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日至平成27年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
				配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548
当中間期変動額									
剰余金の配当							952,560	952,560	952,560
中間純利益							1,671,526	1,671,526	1,671,526
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	718,966	718,966	718,966
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,580,326	21,401,531	32,030,515

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	634,478	634,478	31,946,027
当中間期変動額			
剰余金の配当			952,560
中間純利益			1,671,526
株主資本以外の項 目の当中間期変動額 (純額)	31,294	31,294	31,294
当中間期変動額合計	31,294	31,294	687,672
当中間期末残高	603,184	603,184	32,633,699

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1．資産の評価基準及び評価方法

## (1)有価証券

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2．固定資産の減価償却の方法

## (1)有形固定資産

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2)無形固定資産

定額法によっております。

なお、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

## 3．引当金の計上基準

## (1)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (2)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(中間貸借対照表関係)

第31期中間会計期間 (平成27年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	973,461千円
2.消費税等の取扱い	
<p>仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。</p>	

3. 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。  
当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円

4. 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額337,247千円の支払保証を行っております。

## (中間損益計算書関係)

第31期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
1. 減価償却実施額	
有形固定資産	65,954千円
無形固定資産	95,946千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	21,723千円
雑収入	17,209千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	48,535千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券清算益	24,751千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第31期中間会計期間(自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間 末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	952,560	54,000	平成27年 3月31日	平成27年 7月1日

## (リース取引関係)

第31期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	585,430千円
1年超	1,047,704千円
合計	1,633,134千円

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第31期中間会計期間(平成27年9月30日)

平成27年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。



(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	10,975,719	10,975,719	-
(2)顧客分別金信託	20,003	20,003	-
(3)未収委託者報酬	5,173,183	5,173,183	-
(4)未収運用受託報酬	1,458,560	1,458,560	-
(5)未収投資助言報酬	423,030	423,030	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	10,008,395	10,008,395	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	600,466	600,466	-
資産計	28,659,358	28,659,358	-
(1)顧客からの預り金	29	29	-
(2)未払金			
未払手数料	2,360,638	2,360,638	-
負債計	2,360,667	2,360,667	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

- (1) 現金及び預金、(2) 顧客分別金信託、(3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬、及び  
(5) 未収投資助言報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

- (6) 投資有価証券

これらの時価について、債券については取引金融機関から提示された価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

- (7) 投資その他の資産

## 長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

負 債

- (1) 顧客からの預り金、及び(2) 未払金 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	10
合計	308
子会社株式及び関連会社株式	
非上場株式	10,412,523
合計	10,412,523

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(有価証券関係)

第31期中間会計期間(平成27年9月30日)

1. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 10,412,523千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

3. その他有価証券

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	6,450,671	5,524,611	926,060
小計	6,450,671	5,524,611	926,060
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,557,723	3,605,760	48,037
小計	3,557,723	3,605,760	48,037
合計	10,008,395	9,130,371	878,023

(注)非上場株式等(中間貸借対照表計上額 308千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(資産除去債務等)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第31期中間会計期間(自平成27年4月1日 至平成27年9月30日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位:千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	16,529,753	2,843,500	978,992	64,711	20,416,958

(2)地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が中間損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高の記載を省略しております。

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (1 株当たり情報)

第31期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,849,982円98銭
1株当たり中間純利益	94,757円75銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。</p>	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	32,633,699千円
普通株式に係る純資産額	32,633,699千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	1,671,526千円
普通株式に係る中間純利益	1,671,526千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

イ 受託会社

(イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社  
(ロ) 資本金の額 342,037百万円(平成27年9月末現在)

- (八) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円(平成27年9月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

□ 販売会社

- (イ) 名称 住友生命保険相互会社
- (ロ) 資本金の額 639,000百万円(平成27年9月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。)
- (ハ) 事業の内容 保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

### 第3【その他】

<更新後>

1. 目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマーク、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。
2. 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
3. 目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
4. 目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
5. 有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
6. 目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
7. 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
8. 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。このため、有価証券届出書に他のファンドの情報を合わせて記載することがあります。
9. 当ファンドとスイッチング対象ファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているスミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040の平成27年4月14日から平成27年10月13日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040の平成27年10月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成27年4月14日から平成27年10月13日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

三井住友アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2 . X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成27年 6月15日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 鈴木 敏 夫 印

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 池 ヶ 谷 正 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成27年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成27年4月1日付にて日興グローバルラップ株式会社の発行済株式の全部を取得している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

平成27年11月25日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員

業務執行社員

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 小澤 陽 一 印

公認会計士 池ヶ谷 正 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。